



【2022-11-23】

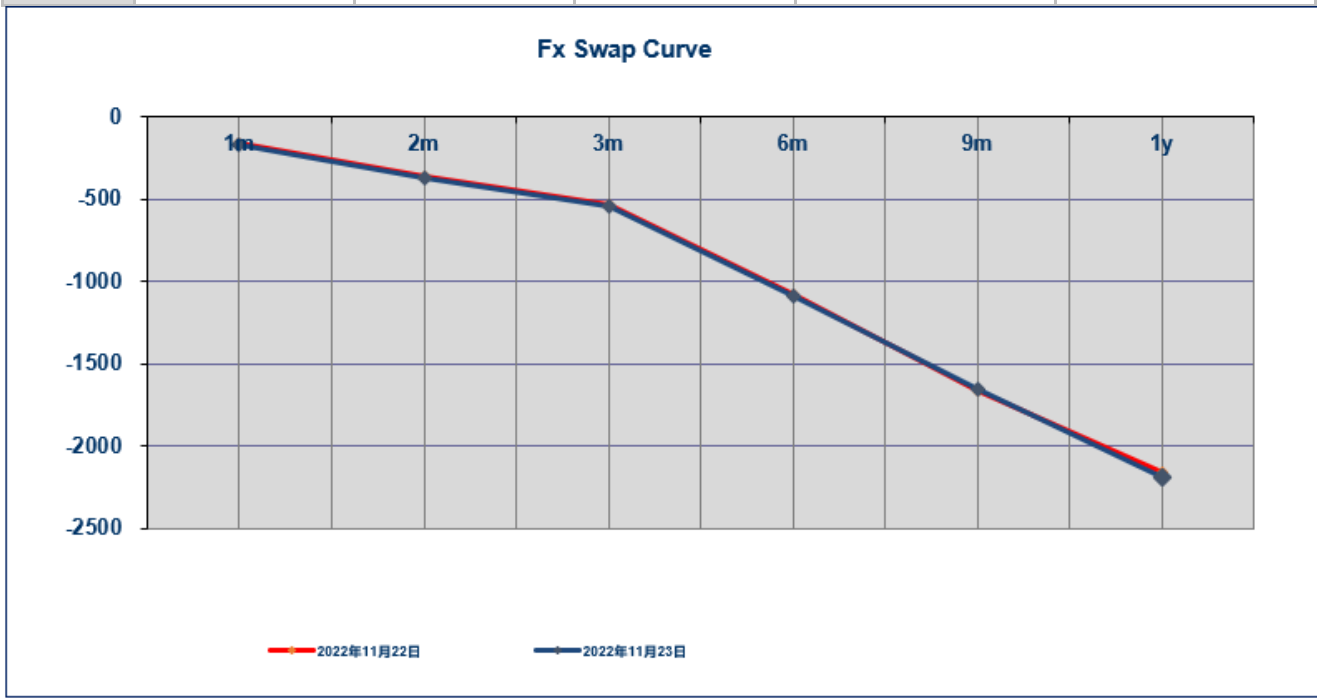
今日美元/人民币中间价报 7.1281，较上一个交易日下调 386bp，各期限收盘价较上一交易日略微下行。

ON 成交在-12.5~-11.5 之间；今日无 TN；SN 成交在-16.2~-16 之间。 1W 成交在-35~-34.5 之间；2W 成交在-74 附近；3W 成交在-112.5~-111 之间。1S 成交在-173~-170 附近；2S 成交在-375~-373 附近；3S 成交在-549~-544 之间。

中长期限，6S 成交在-1100~-1070 附近；9S 成交在-1665~-1655 附近；1Y 在-2200~-2185 之间来回成交。

Tenor	Days	Swap (Mid)	Forward(Mid)	ΔSWAP PIPS
1W	7	-36	7.1506	0.09
2W	14	-74	7.1468	-5
1M	32	-173	7.1370	-6.5
2M	66	-375	7.1167	-9
3M	94	-544	7.0998	-9.1
6M	181	-1087	7.0455	-7
9M	273	-1655	6.9887	9
1Y	367	-2188	6.9354	-23
18M	550	-2875	6.8667	-13.5
2Y	731	-3370	6.8172	5
3Y	1096	-3700	6.7842	0
CNY CENTRAL PARITY RATE			7.1281	
CLOSING SPOT RATE			7.1542	

USD/CNY Spread Ref.					
	2M	3M	6M	9M	1Y
1M	-202.5	-371.6	-914.5	-1482.5	-2015.5
2M		-169.1	-712	-1280	-1813
3M			-542.9	-1110.9	-1643.9
6M				-568	-1101
9M					-533



文 /Cathy He

联系人: Rafael Wang
邮箱: rafael.wang@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日评及更多资讯



免责声明:

以上所含及附加的所有信息（以下简称“信息”）仅用以提供信息，且为保密的和/或者专用的信息，其知识产权属于上海国际货币经纪有限责任公司（以下简称“上海国际货币”）或第三方，“信息”不能也不应被解释为与任何金融工具、投资或任何交易策略相关的报价、出价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据，也不保证其完整性、时效性或准确性等要求，且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均经明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN